

有交易成本的欧式期权定价公式

王杨, 肖文宁, 张寄洲

(上海师范大学数理信息学院 上海 200234)

中图分类号: F830.9

摘要: 在波动率 $\sigma(t)$, 红利率 $q(t)$, 无风险利率 $r(t)$ 均为时间 t 的已知函数和在证券市场中有交易成本的假设下, 得到了欧式期权的定价方程, 从而获得欧式看涨期权和看跌期权的定价公式及它们的平价公式.

关键词: 看涨期权;; 看跌期权;; 交易成本;; 期权定价

 [阅读文章\(pdf\)](#)

关闭本页